

# 易方达黄金交易型开放式证券投资基金管理联接基金

基金管理人：易方达基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
送出日期：二〇一八年八月二十八日

## 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达黄金ETF联接基金
基金代码	000097
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月26日
基金管理人	易方达基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司
报告期末基金资产净值	801,217,042,609.00
基金合同的存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	易方达黄金ETF联接A
下属分级基金的交易代码	000097
报告期末下属分级基金的份额总额	77,426,013,403.00
报告期末下属分级基金的单位净值	72.791,922,117.00

注：自2016年7月1日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2016年7月5日。

### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达黄金交易型开放式证券投资基金
基金代码	160094
基金运作方式	交易型开放式（ETP）
基金合同生效日	2013年10月21日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
报告期末基金资产净值	100,000,000.00
基金合同的存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	易方达黄金ETF联接A
下属分级基金的交易代码	000097
报告期末下属分级基金的份额总额	102,003,000.00

注：自2016年7月1日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2016年7月5日。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要通过完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并定期根据标的指数成份股调整投资组合，以使得投资组合的收益与标的指数的表现相一致。本基金将定期对投资组合进行调整，以降低跟踪误差。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债等）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。
业绩比较基准	上海黄金交易所Au99.99的现货黄金平均收盘价的收益率×90%+活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为交易型开放式基金，长期来看，本基金具有与目标ETF及其所代表的黄金现货挂钩的间接投资风险，同时本基金还可能面临基金自身的管理风险、操作风险和流动性风险。

作为被动管理型基金，报告期内，本基金紧密跟踪上海黄金交易所Au99.99现货黄金的收盘价，具有与上海黄金交易所Au99.99现货黄金价格走势一致的风格收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
法定代表人	陈志列	郭鹤鸣
信息披露负责人	020-85103088	010-66100708
电子邮箱	service@efund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400 881 8818	95588
传真	020-85104966	010-66100709

项目	基金名称	基金代码
基金名称	易方达黄金交易型开放式证券投资基金	160094
基金代码		
基金运作方式	交易型开放式（ETP）	
基金合同生效日	2013年10月21日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	

### 2.4 信息披露方式

基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efund.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江新城路30号广州银行大厦

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元	
3.1.1 利润数据和利润分配	
报告期利润	2018年1月1日至2018年6月30日
本期利润	-1,047,000.00
加权平均基金份额本期利润	-0.0100
本期基金份额净值增长率	-2.23%
期末基金份额净值	97.426,013,403.00
报告期利润总额	10,426,000.00
期末可供分配利润	801,217,042,609.00
报告期利润占可供分配利润的比例(%)	1.29%
注：1. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用，计入费用后实际价值水平将低于所列数字。 2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣减相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。	

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达黄金ETF联接A	
报告期利润	6 半年度财务会计报告(未经审计)
6.1 资产负债表	
会计主体：易方达黄金交易型开放式证券投资基金管理联接基金	
报告截止日：2018年6月30日	
单位：人民币	

资产	本期末	2017年末
资产总计	40,710,045.14	49,616,461.10
负债总计	5,074,204.00	1,102,222.58
净资产	35,635,841.14	48,513,738.52
其中：基金资产总额	35,635,841.14	48,513,738.52
货币资金	35,635,841.14	48,513,738.52
银行存款	35,635,841.14	48,513,738.52
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	0.00	0.00
其中：股票	0.00	0.00
基金投资	35,635,841.14	48,513,738.52
应收利息	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
应付赎回款	5,074,204.00	1,102,222.58
应付交易费用	0.00	0.00
应付所得税款	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付股利	0.00	0.00
应付申购款	0.00	0.00
负债总计	5,074,204.00	1,102,222.58
净资产	35,635,841.14	48,513,738.52
其中：基金资产总额	35,635,841.14	48,513,738.52
货币资金	35,635,841.14	48,513,738.52
银行存款	35,635,841.14	48,513,738.52
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	0.00	0.00
其中：股票	0.00	0.00
基金投资	35,635,841.14	48,513,738.52
应收利息	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
应付赎回款	5,074,204.00	1,102,222.58
应付交易费用	0.00	0.00
应付所得税款	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付股利	0.00	0.00
应付申购款	0.00	0.00

资产	本期末	2017年末
资产总计	40,710,045.14	49,616,461.10
负债总计	5,074,204.00	1,102,222.58
净资产	35,635,841.14	48,513,738.52
其中：基金资产总额	35,635,841.14	48,513,738.52
货币资金	35,635,841.14	48,513,738.52
银行存款	35,635,841.14	48,513,738.52
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	0.00	0.00
其中：股票	0.00	0.00
基金投资	35,635,841.14	48,513,738.52
应收利息	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
负债总计	5,074,204.00	1,102,222.58
净资产	35,635,841.14	48,513,738.52
其中：基金资产总额	35,635,841.14	48,513,738.52
货币资金	35,635,841.14	48,513